

VILNIAUS UNIVERSITETAS
MATEMATIKOS IR INFORMATIKOS FAKULTETAS
EKONOMETRINĖS ANALIZĖS KATEDRA

"Palūkanų normos prognozė"
Kursinio projekto planas

0. Įvadas:
 - 0.1. Tikslų ir uždavinių suformulavimas.
1. Teorinė dalis:
 - 1.1. Palūkanų normos apibrėžtis, jos esmė, ir vaidmuo šiuolaikinėje ekonomikoje.
2. Pradinė duomenų analizė:
 - 2.1. Palūkanų normos ir veiksnių, darančių jai įtaką, duomenų surinkimas.
 - 2.2. Grafikų brėžimas ir aptarimas, tendencijų išskyrimas.
 - 2.3. Vienetinės šaknies nustatymas ir gautų rezultatų interpretavimas.
3. Modeliai:
 - 3.1. ARIMA modelis:
 - 3.1.1. Trumpas ARIMA modelio pristatymas.
 - 3.1.2. Tinkamiausio modelio parinkimas, galimų problemų nustatymas ir pašalinimas.
 - 3.1.3. Prognozė ir jos palyginimas su tikrais duomenimis.
 - 3.2. VAR modelis:
 - 3.2.1. Trumpas VAR modelio pristatymas.
 - 3.2.2. VAR modelio sudarymas, kointegruotumo tikrinimas.
 - 3.2.3. Granger'io priežastingumo tikrinimas.
 - 3.2.4. VAR modelio prognozė.
4. Išvados:
 - 4.1. Gautų rezultatų aptarimas, įvertinimas ekonominiu ir ekonometrinio aspektu.

Ekonometrija, 3 kursas, 2 grupė
Rūta Ivanauskaitė ir Sandra Petrauskaitė
Vadovas: Dr. Doc. Remigijus Lapinskas